

**ÉMISSIONS DES OBLIGATIONS DU GOUVERNEMENT DU CANADA LIVRABLES  
ET LEURS FACTEURS DE CONCORDANCE  
(le 24 août 2023, modifié le 1er septembre 2023)**

**CONTRATS À TERME SUR OBLIGATIONS DU GOUVERNEMENT DU CANADA DE TRENTE ANS – LGB**

Obligations du gouvernement du Canada		Montant en cours (CAN \$ million)	Septembre 2023	Decembre 2023	Mars 2024	Juin 2024
Coupon	Échéance					
1.75%	1er décembre 2053	32000	0.4101	0.4119	0.4137	0.4155
2.75%	1er décembre 2055	6750	0.5388	0.5400	0.5412	0.5425
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			38750	38750	38750	38750

POUVANT FAIRE L'OBJET D'UNE LIVRAISON (millions \$ CAN)

Facteurs de conversion calculés sur la base d'un rendement de 6 %

**CONTRATS À TERME SUR OBLIGATIONS DU GOUVERNEMENT DU CANADA DE DIX ANS – CGB**

Obligations du gouvernement du Canada		Montant en cours (CAN \$ million)	Septembre 2023	Decembre 2023	Mars 2024	Juin 2024
Coupon	Échéance					
1.5%	1er décembre 2031	32000	0.7105	0.7174		
2%	1er juin 2032	24000	0.7307	0.7367	0.7426	0.7488
2.5%	1er decembre 2032	21000	0.7542	0.7593	0.7644	0.7696
2.75%	1er juin 2033	19000	0.7627	0.7672	0.7718	0.7765
3.25%	1er décembre 2033	6500	0.7917	0.7954	0.7992	0.8030
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			102500	102500	70500	70500

POUVANT FAIRE L'OBJET D'UNE LIVRAISON (millions \$ CAN)

Facteurs de conversion calculés sur la base d'un rendement de 6 %

**CONTRATS À TERME SUR OBLIGATIONS DU GOUVERNEMENT DU CANADA DE CINQ ANS – CGF**

Obligations du gouvernement du Canada		Montant en cours (CAN \$ million)	Septembre 2023	Decembre 2023	Mars 2024	Juin 2024
Coupon	Échéance					
3.5%	1er mars 2028	15000	0.9027			
3.25%	1er septembre 2028	20000	0.8827	0.8877	0.8929	
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			35000	20000	20000	N/A

POUVANT FAIRE L'OBJET D'UNE LIVRAISON (millions \$ CAN)

Facteurs de conversion calculés sur la base d'un rendement de 6 %

**CONTRATS À TERME SUR OBLIGATIONS DU GOUVERNEMENT DU CANADA DE DEUX ANS - CGZ**

Obligations du gouvernement du Canada		Montant en cours (CAN \$ million)	Septembre 2023	Decembre 2023	Mars 2024	Juin 2024
Coupon	Échéance					
3.75%	1er mai 2025	15250	0.9648			
3.5%	1er août 2025	19000	0.9553	0.9608		
3%	1er octobre 2025	10000	0.9420			
4.5%	1er novembre 2025	9500	0.9699	0.9732	0.9765	
3%	1er avril 2026	10000		0.9355	0.9420	0.9486
TOTAL DU MONTANT EN COURS DES OBLIGATIONS			53750	38500	19500	10000

POUVANT FAIRE L'OBJET D'UNE LIVRAISON (millions \$ CAN)

Facteurs de conversion calculés sur la base d'un rendement de 6 %

Note: Cette liste est produite conformément aux Règles de Bourse de Montréal Inc. et de la Corporation canadienne de compensation de produits dérivés (CDCC).

Les montants en cours sont représentatifs du marché à la date de publication de ce document et sont fournis à titre informatif seulement.

Les limites de positions déterminées et publiées par la division de la Réglementation de la Bourse peuvent être basées sur des montants différents